



セミナー情報

2018年8月 セミナー一覧

2018.8.10 (金) | セミナー

確率論セミナー (15:30--17:00【会場：数学棟305】)

発表者：濱名 裕治 氏 (熊本大学大学院自然科学教育部)

題目：Ornstein-Uhlenbeck 過程の到達時刻について

概要：

Ornstein-Uhlenbeck 過程の半径方向の運動はRadial Ornstein-Uhlenbeck 過程とよばれる1次元拡散過程である。

この到達時刻の Laplace 変換は合流型超幾何関数の比でかけることがわかっている。その逆変換を求めることにより、到達時刻の分布関数や密度関数を、合流型超幾何関数とその第1パラメータに関する零点で表示できることを解説する。
